

Espaces préhilbertiens réels

I Espaces préhilbertiens réels

1. Produit scalaire et norme euclidienne

Définition : Soient E un \mathbb{R} -espace vectoriel. Un **produit scalaire** sur E est une **forme bilinéaire symétrique définie positive**, ie une application

$$\begin{aligned}\varphi : E \times E &\longrightarrow \mathbb{R} \\ (u, v) &\longmapsto (u|v)\end{aligned}$$

telle que :

1. $\forall(\alpha, \beta) \in \mathbb{R}^2, \forall(u, v, w) \in E^3, \begin{cases} (\alpha u + \beta v|w) = \alpha(u|w) + \beta(v|w) & (\text{linéaire à gauche}) \\ \text{et} \\ (u|\alpha v + \beta w) = \alpha(u|v) + \beta(u|w) & (\text{linéaire à droite}) \end{cases}$
2. $\forall(u, v) \in E^2, (u|v) = (v|u).$
3. $\forall u \in E, (u|u) \geq 0$
4. $\forall u \in E, (u|u) = 0 \Rightarrow u = 0$

La **norme euclidienne** associée est alors définie sur E par

$$\forall u \in E, \|u\| = \sqrt{(u|u)}$$

Un **espace préhilbertien réel** est un \mathbb{R} -espace vectoriel muni d'un produit scalaire.

Remarque(s) :

- (I.1) Pour montrer que φ est bilinéaire et symétrique, il suffit de prouver que φ est symétrique et linéaire à gauche (ou à droite).
- (I.2) Une forme bilinéaire symétrique positive est une application $\varphi : E^2 \rightarrow \mathbb{R}$ qui ne vérifie que les propriétés **1**, **2** et **3** de la définition précédente. L'application $u \mapsto \sqrt{(u|u)}$ est alors définie sur E mais ce n'est plus une norme.

Exemple(s) :

- (I.3) Si $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ alors $\varphi_A : (X, Y) \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})^2 \mapsto X^T A Y$ est bilinéaire. De plus φ_A est symétrique si et seulement si A est symétrique (ie $A = A^T$).

Définition [I.1] : (Produits scalaires usuels)

1. Le produit scalaire canonique sur \mathbb{R}^n est défini par

$$(x|y) = \sum_{i=1}^n x_i y_i = X^T Y$$

si $x = (x_1, \dots, x_n)$ et $y = (y_1, \dots, y_n)$ où $X = \text{Mat}_{\mathcal{B}_c}(x)$ et $Y = \text{Mat}_{\mathcal{B}_c}(y)$ avec \mathcal{B}_c la base canonique de \mathbb{R}^n .

2. Le produit scalaire canonique sur $\mathcal{M}_{n,p}(\mathbb{R})$ est défini par

$$(A|B) = \text{Tr}(A^T B).$$

3. Sur $\mathcal{C}^0([a,b], \mathbb{R})$, on définit un produit scalaire en posant

$$(f|g) = \int_a^b f(t)g(t) dt$$

ou plus généralement $(f|g) = \int_a^b f(t)g(t)u(t) dt$ où $u \in \mathcal{C}^0([a,b], \mathbb{R})$ est strictement positive sur $[a,b]$.

Remarque(s) :

- (I.4) Il ne faut pas confondre le produit scalaire canonique sur \mathbb{R}^n , $(X|Y) = X^T Y$ avec X et Y des vecteurs colonnes, et le produit scalaire canonique sur $\mathcal{M}_{n,p}(\mathbb{R})$, $(A|B) = \text{Tr}(A^T B)$ avec A et B des matrices.

Exemple(s) :

(I.5) $(P|Q) = \int_a^b P(t)Q(t) dt$ avec $a < b$ définit un produit scalaire sur $\mathbb{R}[X]$.

(I.6) Le produit scalaire canonique sur $\mathbb{R}_n[X]$ est $(P|Q) = \sum_{k=0}^n a_k b_k = \sum_{k=0}^n \frac{P^{(k)}(0)}{k!} \times \frac{Q^{(k)}(0)}{k!}$ avec
 $P = \sum_{k=0}^n a_k X^k$ et $Q = \sum_{k=0}^n b_k X^k$.

- (I.7) Sur l'ensemble E des fonctions continues et de carré intégrable sur I (ie telles que f^2 est intégrable sur I), on définit un produit scalaire par $(f|g) = \int_I f g$.

Propriété [I.2] : Soient E un \mathbb{R} -espace vectoriel muni d'un produit scalaire $(\cdot | \cdot)$

1. (Identités remarquables)

$$\forall (u, v) \in E^2, \|u + v\|^2 = \|u\|^2 + 2(u|v) + \|v\|^2 \text{ et } \|u - v\|^2 = \|u\|^2 - 2(u|v) + \|v\|^2$$

2. (Identités de polarisation)

$$\begin{aligned} \forall (u, v) \in E^2, (u|v) &= \frac{1}{2} (\|u + v\|^2 - \|u\|^2 - \|v\|^2) \\ &= \frac{1}{2} (\|u\|^2 + \|v\|^2 - \|u - v\|^2) \\ &= \frac{1}{4} (\|u + v\|^2 - \|u - v\|^2) \end{aligned}$$

Propriété [I.3] : (Inégalité de Cauchy-Schwarz)

Soit E un espace préhilbertien réel, on a :

$$\forall (u, v) \in E^2, |(u|v)| \leq \|u\| \times \|v\|$$

De plus $|(u|v)| = \|u\| \times \|v\|$ si et seulement si u et v sont liés.

Remarque(s) :

- (I.8) Si φ est une forme bilinéaire symétrique positive, on a encore $|\varphi(u, v)| \leq \sqrt{\varphi(u, u)} \times \sqrt{\varphi(v, v)}$ mais la caractérisation de l'égalité n'est vraie que pour un produit scalaire.

Exemple(s) :

(I.9) Si f et g sont \mathcal{CM}^0 et de carrés intégrables sur I alors fg est intégrable sur I et

$$\left(\int_I f(t)g(t) dt \right)^2 \leq \left(\int_I f(t)^2 dt \right) \left(\int_I g(t)^2 dt \right)$$

Si de plus f et g sont continues sur I alors on a égalité si et seulement si f et g sont liées.

Propriété [I.4] : (Inégalité triangulaire ou inégalité de Minkowski)

Soient E un espace préhilbertien réel, on a :

$$\forall (u, v) \in E^2, \|u + v\| \leq \|u\| + \|v\|$$

De plus $\|u + v\| = \|u\| + \|v\|$ si et seulement si u et v sont positivement liés (ie $\exists \lambda \in \mathbb{R}^+, u = \lambda v$ ou $v = \lambda u$).

Remarque(s) :

(I.10) Si φ est une forme bilinéaire symétrique positive et q la forme quadratique associée, on a encore $\sqrt{q(u+v)} \leq \sqrt{q(u)} + \sqrt{q(v)}$ mais la caractérisation de l'égalité n'est vraie que pour un produit scalaire.

Conséquence [I.5] : Soient E un espace préhilbertien réel et $(|)$ le produit scalaire.

L'application $x \in E \mapsto \|x\| = \sqrt{(x|x)}$ est une norme sur E .

Exemple(s) :

(I.11) Soit $A \in \mathcal{M}_{n,p}(\mathbb{R})$. Montrer que $\ker(A) = \ker(A^T A)$ et $\text{Im}(A^T) = \text{Im}(A^T A)$.

2. Orthogonalité

Définition : Soient $(E, (|))$ un espace préhilbertien et $(u, v) \in E^2$.

1. On dit que u est **unitaire** (ou normé) si $\|u\| = 1$.
2. On dit que u et v sont **orthogonaux** si $(u|v) = 0$; on le note $u \perp v$.

Remarque(s) :

(I.12) Si $x \neq 0$ alors $\frac{x}{\|x\|}$ est unitaire.

(I.13) Dans un espace préhilbertien réel, si $\|x\| = \|y\|$ alors $(x+y) \perp (x-y)$.

Définition : Soient $(E, (|))$ un espace préhilbertien et $(x_i)_{i \in I}$ une famille de vecteurs de E .

1. On dit que $(x_i)_{i \in I}$ est **orthogonale** si $\forall (i, j) \in I^2, i \neq j \Rightarrow (x_i|x_j) = 0$.
2. On dit que $(x_i)_{i \in I}$ est **orthonormale** (ou orthonormée) si $\forall (i, j) \in I^2, (x_i|x_j) = \delta_{ij}$.

Propriété [I.6] : Soit E un espace préhilbertien.

1. Toute famille orthogonale de vecteurs non nuls est libre.
2. Si $(x_i)_{1 \leq i \leq n}$ est une famille orthogonale alors $\left\| \sum_{i=1}^n x_i \right\|^2 = \sum_{i=1}^n \|x_i\|^2$ (théorème de Pythagore).

Définition : Soient $(E, (\cdot | \cdot))$ un espace préhilbertien, F et G deux sous-espaces vectoriels de E . On dit que F et G sont **orthogonaux** si $\forall (x, y) \in F \times G, (x|y) = 0$; on le note $F \perp G$.

Propriété [I.7] : Soient E un espace préhilbertien et F_1, \dots, F_n des sous-espaces vectoriels de E , 2 à 2 orthogonaux.

Alors la somme de F_i est directe : $\sum_{i=1}^n F_i = \bigoplus_{i=1}^n F_i$.

Définition : Soient $(E, (\cdot | \cdot))$ un espace préhilbertien et X une partie (quelconque) de E . On définit l'**orthogonal** de X , noté X^\perp par

$$X^\perp = \{u \in E, \forall x \in X, (u|x) = 0\}$$

Exemple(s) :

(I.14) Dans \mathbb{R}^4 canoniquement euclidien, déterminer l'orthogonal de $F = \{(x, y, z, t) \in \mathbb{R}^4, x + y - z = 2x - y - 2t = 0\}$.

(I.15) Dans $\mathbb{R}_3[X]$ muni du produit scalaire $(P|Q) = \int_0^1 P(t)Q(t) dt$, déterminer l'orthogonal de l'espace $F = \{P \in \mathbb{R}_3[X], P(0) = P'(1) = 0\}$.

Propriété [I.8] : Soient $(E, (\cdot | \cdot))$ un espace préhilbertien , X et Y deux parties de E .

1. X^\perp est un sous-espace vectoriel de E .
2. $X^\perp = \text{Vect}\{X\}^\perp$
3. Si $X \subset Y$ alors $Y^\perp \subset X^\perp$.
4. $X \cap X^\perp \subset \{0\}$ et $X \subset (X^\perp)^\perp$.
5. $X \perp Y \Leftrightarrow X \subset Y^\perp \Leftrightarrow Y \subset X^\perp$.

Remarque(s) :

(I.16) On peut avoir $(F^\perp)^\perp \neq F$ même si F est un sev de E ; c/ex : dans $\mathbb{R}[X]$ muni de $(P|Q) = \int_0^1 P(t)Q(t) dt$, avec le sous-espace $F = \{P \in \mathbb{R}[X], P(0) = 0\}$.

Exemple(s) :

(I.17) Si F et G sont deux sous-espaces vectoriels de E , on a $(F+G)^\perp = F^\perp \cap G^\perp$ et $F^\perp + G^\perp \subset (F \cap G)^\perp$.

II Espaces euclidiens

Définition : Un **espace euclidien** est un espace préhilbertien réel de dimension finie.

Remarque(s) :

(II.1) Tout espace vectoriel réel de dimension finie peut être muni d'un produit scalaire, qui en fait donc un espace euclidien.

1. Bases orthonormales

Définition : Soient E un espace euclidien et \mathcal{B} une famille de vecteurs de E . On dit que \mathcal{B} est une **base orthonormale** (ou orthonormée) de E si \mathcal{B} est base de E et une famille orthonormale de E .

Remarque(s) :

(II.2) Pour montrer que \mathcal{B} est une base orthonormée de E , il suffit de prouver que \mathcal{B} est une famille orthonormale et génératrice.

- (II.3) Si on sait de plus que $\dim E = n$ et si \mathcal{B} comporte n vecteurs, pour montrer que \mathcal{B} est une base orthonormale de E , il suffit de prouver que \mathcal{B} est orthonormale.

Propriété [II.1] : (Procédé d'orthonormalisation de Gram-Schmidt)

Soient E un espace euclidien et $\mathcal{B} = (e_1, \dots, e_n)$ une base de E . Alors il existe une base orthonormale $\mathcal{B}_\perp = (f_1, \dots, f_n)$ de E telle que

$$\forall k \in \llbracket 1, n \rrbracket, \text{Vect}\{e_1, \dots, e_k\} = \text{Vect}\{f_1, \dots, f_k\}$$

ie telle que la matrice de passage $P(\mathcal{B}, \mathcal{B}_\perp)$ est triangulaire supérieure.

Les vecteurs de \mathcal{B}_\perp sont définis par

$$\begin{cases} f_1 = \frac{e_1}{\|e_1\|} \\ f_k = \frac{g_k}{\|g_k\|} \text{ avec } g_k = e_k - \sum_{j=1}^{k-1} (f_j | e_k) f_j \text{ si } k \geq 2 \end{cases}$$

Remarque(s) :

- (II.4) Il est indispensable savoir appliquer ce procédé de façon à construire une base d'un espace préhilbertien mais aussi de connaître l'énoncé de cette propriété (pour des exercices plus théoriques).

Exemple(s) :

- (II.5) Déterminer une base orthonormale de $\mathbb{R}_2[X]$ pour le produit scalaire $(P|Q) = P(-1)Q(-1) + P(0)Q(0) + P(1)Q(1)$.
- (II.6) Soit $(|)$ un produit scalaire sur $\mathbb{R}_n[X]$. Il existe une base (P_0, \dots, P_n) de $\mathbb{R}_n[X]$ telle que, pour tout $k \in \llbracket 0, n \rrbracket$, $\deg(P_k) = k$.

Conséquence [II.2] : Soit E un espace euclidien.

1. E possède une base orthonormale.
2. Toute famille orthonormale de E peut être complétée en un base orthonormale de E (théorème de la base orthonormée incomplète).

Remarque(s) :

- (II.7) Si $E = \bigoplus_{1 \leq i \leq p}^\perp F_i$ et si \mathcal{B}_i est une base orthonormale de F_i (pour tout indice i) alors $(\mathcal{B}_1, \dots, \mathcal{B}_p)$ est une base orthonormale de E adaptée à cette décomposition.

Propriété [II.3] : (Calculs dans une base orthonormale)

Soient E un espace euclidien et $\mathcal{B} = (e_1, \dots, e_n)$ une base orthonormale de E .

1. Si $x \in E$, on a

$$x = \sum_{i=1}^n (e_i | x) e_i$$

2. Si $x = \sum_{i=1}^n x_i e_i$ et $y = \sum_{i=1}^n y_i e_i$ alors on a, avec $X = \text{Mat}_{\mathcal{B}}(x)$ et $Y = \text{Mat}_{\mathcal{B}}(y)$:

$$(x|y) = \sum_{i=1}^n x_i y_i = \sum_{i=1}^n (e_i | x)(e_i | y) = X^T Y \quad \text{et} \quad \|x\|^2 = \sum_{i=1}^n x_i^2 = \sum_{i=1}^n (e_i | x)^2 = X^T X$$

Remarque(s) :

- (II.8) Si on pose $\varphi_i(x) = (e_i | x)$ alors $(\varphi_1, \dots, \varphi_n)$ une base de $\mathcal{L}(E, \mathbb{R})$ telle que $\varphi_i(e_j) = \delta_{i,j}$.

Conséquence [II.4] : Soient E un espace euclidien, $\mathcal{B} = (e_1, \dots, e_n)$ une base orthonormale de E , $f \in \mathcal{L}(E)$ et $A = (a_{i,j})_{1 \leq i,j \leq n} = \text{Mat}_{\mathcal{B}}(f)$. Alors pour $(i, j) \in \llbracket 1, n \rrbracket^2$, on a

$$a_{i,j} = (e_i | f(e_j)).$$

2. Formes linéaires et hyperplans

Propriété [II.5] : Soient $(E, (\cdot | \cdot))$ un espace euclidien et φ une forme linéaire sur E . Alors il existe un unique $a \in E$ tel que

$$\forall x \in E, \varphi(x) = (a|x)$$

Exemple(s) :

- (II.9) Dans $\mathbb{R}_2[X]$ muni du produit scalaire $(P|Q) = \sum_{i=0}^2 P(i)Q(i)$, déterminer le polynôme $A \in \mathbb{R}_2[X]$ tel que $\forall P \in \mathbb{R}_2[X], \int_0^1 tP(t) dt = (A|P)$.

Remarque(s) :

- (II.10) En dimension infinie l'existence de a tel que $\forall x \in E, \varphi(x) = (a|x)$ n'est pas assurée ; c/ex : sur $\mathcal{C}^0([0, 1], \mathbb{R})$ muni de $(f|g) = \int_0^1 f(t)g(t) dt$ avec $\varphi : f \mapsto f(0)$.

Définition : Soient E un espace euclidien et H un hyperplan de E . On appelle **vecteur normal à H** tout vecteur non nul de H^\perp .

Remarque(s) :

- (II.11) On a alors $H^\perp = \text{Vect}\{a\}$ ou $E = H^\perp \overset{\perp}{\oplus} \text{Vect}\{a\}$.

Propriété [II.6] : Soient E un espace euclidien et $\mathcal{B} = (e_1, \dots, e_n)$ une base orthonormale de E

1. Si H est un hyperplan de E , il existe un vecteur a non nul de E tel que

$$H = \{x \in E, (a|x) = 0\}$$

Le vecteur a est alors un vecteur normal à H .

Si $a = a_1e_1 + \dots + a_ne_n$ alors $x = x_1e_1 + \dots + x_ne_n \in H$ si et seulement si $a_1x_1 + \dots + a_nx_n = 0$ (équation cartésienne de H dans la base \mathcal{B}).

2. Inversement, si $H = \{x = x_1e_1 + \dots + x_ne_n \text{ tq } a_1x_1 + \dots + a_nx_n = 0\}$ avec $(a_1, \dots, a_n) \neq (0, \dots, 0)$ alors H est un hyperplan de E et $a = a_1e_1 + \dots + a_ne_n$ est un vecteur normal à H .

3. Projecteurs orthogonaux

Propriété [II.7] : Soient E un espace préhilbertien et F un sous-espace vectoriel de E . Si F est de dimension finie alors F^\perp et F sont supplémentaires dans E :

$$E = F \overset{\perp}{\oplus} F^\perp$$

F^\perp est appelé **le supplémentaire orthogonal de F** .

Conséquence [II.8] : Soient E un espace euclidien et F un sous-espace vectoriel de E . Alors on a

1. $\dim(F^\perp) = \dim(E) - \dim(F)$.
2. $(F^\perp)^\perp = F$.

Exemple(s) :

(II.12) Si $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et si \mathbb{R}^n est canoniquement euclidien, on a $(\ker A)^\perp = \text{Im}(A^T)$ et $(\text{Im } A)^\perp = \ker(A^T)$.

(II.13) Si F et G sont deux sous-espaces vectoriels de E , euclidien, on a $F^\perp + G^\perp = (F \cap G)^\perp$.

Définition [II.9] : Soient E un espace préhilbertien et F un sous-espace vectoriel de E de dimension finie. La **projection orthogonale** sur F est la projection sur F parallèlement à F^\perp .

Si $x \in E$ alors le projeté orthogonal de x sur F est donc l'unique vecteur $\pi_F(x)$ tel que

$$\pi_F(x) \in F \quad \text{et} \quad x - \pi_F(x) \in F^\perp$$

Remarque(s) :

(II.14) $p \in \mathcal{L}(E)$ est un projecteur orthogonal si et seulement si $p \circ p = p$ et $\ker(p) \perp \text{Im}(p)$.

Exemple(s) :

(II.15) Soit p un projecteur de E euclidien. Montrer que p est un projecteur orthogonal si et seulement si $\forall x \in E, \|p(x)\| \leq \|x\|$

Conséquence [II.9] : Soient E un espace préhilbertien et F un sous-espace vectoriel de E de dimension finie. Si (f_1, \dots, f_k) est une famille génératrice de F et $x \in E$, $\pi_F(x)$ est donc l'unique vecteur de E tel que

$$\pi_F(x) \in F \text{ et } \forall i \in \llbracket 1, k \rrbracket, (x - \pi_F(x)|f_i) = 0$$

Exemple(s) :

(II.16) Soit $E = C^\infty([0, \pi], \mathbb{R})$ muni du produit scalaire $(f|g) = \int_0^\pi f(t)g(t) dt$. Déterminer le projeté orthogonal de id sur $F = \{f \in E, f'' + f = 0\}$.

Propriété [II.10] : Soient $(E, (\cdot))$ un espace préhilbertien, F un sous-espace vectoriel de dimension finie et (e_1, \dots, e_p) une base orthonormale de F . Alors, pour $x \in E$, le projeté orthogonal de x sur F est

$$\pi_F(x) = \sum_{i=1}^p (e_i|x)e_i$$

Exemple(s) :

(II.17) Dans \mathbb{R}^4 , canoniquement euclidien, écrire la matrice dans la base canonique de \mathbb{R}^4 de la projection orthogonale sur $F = \{(x, y, z, t) \in \mathbb{R}^4, x + y + z + t = x + 2y + 3z + 4t = 0\}$.

Définition [II.11] : Soient E un espace préhilbertien, F un sous-espace vectoriel de E et $x \in E$. La **distance de x à F** est

$$d(x, F) = \inf_{y \in F} \|x - y\|$$

Propriété [II.12] : Soient E un espace préhilbertien, F un sous-espace vectoriel de E de dimension finie et $x \in E$. Alors $d(x, F) = \min_{y \in F} \|x - y\|$ est atteinte en un point unique de F , le projeté orthogonal $\pi_F(x)$ de x sur F :

$$d(x, F)^2 = \|x - \pi_F(x)\|^2 = \|x\|^2 - \|\pi_F(x)\|^2$$

Exemple(s) :

(II.18) Déterminer $\inf_{(a,b) \in \mathbb{R}^2} \int_0^1 (e^x - ax - b)^2 dx$.

(II.19) On note $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$ l'ensemble des matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ symétriques, $\mathcal{A}_n(\mathbb{R})$ l'ensemble des matrices antisymétriques.

a) Montrer que $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$ et $\mathcal{A}_n(\mathbb{R})$ sont supplémentaires orthogonaux pour le produit scalaire canonique de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

b) Pour $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ donnée, déterminer $\inf_{M \in \mathcal{S}_n(\mathbb{R})} \sum_{1 \leq i,j \leq n} (a_{i,j} - m_{i,j})^2$.

Conséquence [II.13] : Soient E un espace euclidien et $x \in E$.

1. Si $D = \text{Vect}\{e\}$ est une droite de E alors $\pi_D(x) = \frac{(e|x)}{\|e\|^2}e$ et $d(x, D)^2 = \|x\|^2 - \frac{(e|x)^2}{\|e\|^2}$.

2. Si $H = \{e\}^\perp$ est un hyperplan de E , dont e est un vecteur normal, alors on a $\pi_H(x) = x - \pi_D(x) = x - \frac{(e|x)}{\|e\|^2}e$, où $D = \text{Vect}\{e\} = H^\perp$ est la droite supplémentaire orthogonale de H et $d(x, H) = \frac{|(e|x)|}{\|e\|}$.

Remarque(s) :

(II.20) Soit $\mathcal{D} = \{(x, y) \in \mathbb{R}^2, ax + by + c = 0\}$ avec $(a, b) \neq (0, 0)$ une droite affine de \mathbb{R}^2 , canoniquement euclidien, et $M_0 = (x_0, y_0)$ un point de \mathbb{R}^2 . La distance de M_0 à la droite \mathcal{D} est

$$d(M_0, \mathcal{D}) = \inf_{M \in \mathcal{D}} \|\overrightarrow{M_0 M}\| = \frac{|ax_0 + by_0 + c|}{\sqrt{a^2 + b^2}}$$